

南方沪深 300 指数证券投资基金 2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2012 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	41
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	41
7.9 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	43
§9 开放式基金份额变动	43

§10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	46
§11 备查文件目录	48
11.1 备查文件目录.....	48
11.2 存放地点.....	48
11.3 查阅方式.....	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方沪深 300 指数证券投资基金
基金简称	南方沪深 300 指数
基金主代码	202015
前端交易代码	202015
后端交易代码	202016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 3 月 25 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,893,046,976.07 份
基金合同存续期	不定期

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方 300”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%，以实现沪深 300 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+一年期银行定期存款收益率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	赵会军
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798
注册地址		深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		吴万善	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理有限公司	深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2012年1月1日 - 2012年6月30日)
本期已实现收益	-126,219,815.08
本期利润	122,930,328.66
加权平均基金份额本期利润	0.0439
本期加权平均净值利润率	5.02%
本期基金份额净值增长率	5.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配利润	-429,107,716.80
期末可供分配基金份额利润	-0.1483
期末基金资产净值	2,463,939,259.27
期末基金份额净值	0.8517
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-2.88%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润, 采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额, 不是当期发生数)。

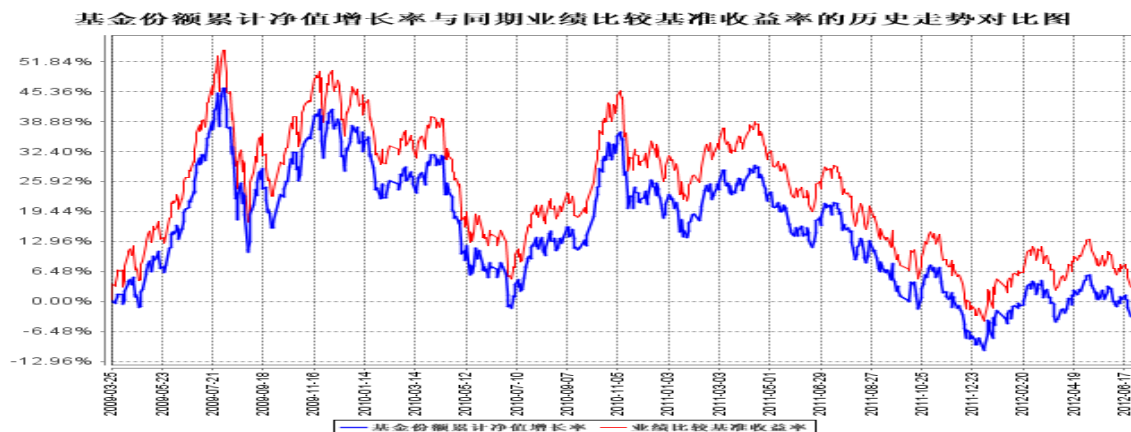
3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-5.44%	1.04%	-6.14%	1.04%	0.70%	0.00%
过去三个月	1.13%	1.06%	0.32%	1.07%	0.81%	-0.01%
过去六个月	5.43%	1.26%	4.82%	1.26%	0.61%	0.00%
过去一年	-17.81%	1.28%	-18.05%	1.28%	0.24%	0.00%
过去三年	-21.30%	1.49%	-20.59%	1.49%	-0.71%	0.00%
自基金合同生效起至今	-2.88%	1.48%	3.31%	1.49%	-6.19%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金建仓期为三个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。由于本基金正式跟踪标的指数起始日为 2009 年 5 月 1 日，因此上图未能体现本基金建仓期之后拟合业绩基准的情况。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[1998]4 号文批准，由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000 年，经中国证监会证监基金字[2000]78 号文批准进行了增资扩股，注册资本达到 1 亿元人民币。2005 年，经中国证监会证监基金字[2005]201 号文批准进行增资扩股，注册资本达 1.5 亿元人民币。2010 年，经证监许可[2010]1073 号文核准深圳市机场（集团）有限公司将其持有的 30%股权转让给深圳市投资控股有限公司。目前股权结构：华泰证券股份有限公司 45%、深圳市投资控股有限公司 30%、厦门国际信托有限公司 15%及兴业证券股份有限公司 10%。公司在北京、上海、合肥等地设有分公司，在香港设有子公司—南方东英资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理资产规模近 2,000 亿元，旗下管理 32 只开放式基金，2 只封闭式基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
潘海宁	本基金的基金经理	2009年3月25日	-	11	会计学学士，具有基金从业资格。曾先后任职于兴业证券股份有限公司、富国基金管理有限公司。2003年3月加入南方基金，历任行业研究员、基金开元基金经理助理、投资部总监助理、数量化投资部总监助理等职务。2009年3月至今，任南方300指数基金经理；2009年12月至今，任南方深成ETF及联接基金基金经理；2011年2月至今，任南方500基金经理。
罗文杰	本基金的基金经理助理	2011年2月28日	-	7	美国南加州大学金融数学专业硕士、美国加州大学计算机专业硕士，双硕士学历。曾任职于美国Open Link Financial公司、美国摩根斯坦利公司，参与利率及衍生品定价模型的相关工作。2008年加盟南方基金，现任数量化投

					资部金融工程研究员；2011 年 2 月至今，任南方小康及小康 ETF、南方 300、南方 500、深成 ETF 及南方深成基金经理助理；2011 年 10 月至今，任南方上证 380ETF 及其联接基金的基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日；除首任基金经理外，“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则，并严格按照《南方沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的各项规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求与标的指数相近的收益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 14 次，其中 12 次是由于报告期初指数基金成份股调整，1 次是由于接受大额申购使得基金规模增大，配置债券所需，1 次是由于社保 201 组合调整，选择期限与收益匹配较好的债券进行投资的需要。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012 年以来，中央针对经济增速下滑推出了稳健偏松的货币政策和相对积极的财政政策，使得上半年沪深 300 指数相对去年末的低点有所回升，涨幅为+4.94%。

期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

①接受大额申购、赎回所带来的股票仓位偏离，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

②个别长期停牌证券，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

③部分成份股分红引起的基金净值相对于业绩基准的正向偏离；

④6 月底前后，我们根据指数每半年度的成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自本基金建仓完成至报告期末年化跟踪误差为 0.613%，今年初至报告期末年化跟踪误差为 0.422%，较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过 4% 的投资目标，并保持业内同类领先。

截至报告期末，本基金份额净值为 0.8517 元，报告期内，份额净值增长率为 5.43%，同期业绩基准增长率为 4.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在全球经济增速低迷的背景下，中国也面临着经济放缓的局面。但和欧美发达国家相比，中国仍可依靠降息、下调存款准备金率、财政刺激计划等传统的政策工具。如果下半年经济增速没有企稳回升，央行可以再次降息和下调存款准备金率，促使银行加大贷款力度；也可以在不威胁到政府偿付能力的前提下，增加基础设施开支和对消费者的补贴。面对经济困境，中国显然有更多灵活的办法来应对。

另一方面，我们看到中国是在全球经济衰退中为数不多的几个依然保持经济增长的国家之一，但国内 A 股的走势与深受金融危机和主权债务危机的美欧及部分东南亚国家的股指相比，似乎并未同步反应中国经济的相对强势。相信每位投资者都可以对这样的现象分析出自己的观点，但我们始终认为长期而言股市仍应与国民经济的发展保持一致。下半年随着更多的政策利好信号和流动性进一步改善，A 股市场中长期的投资价值正逐渐显现。

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

对于没有太多精力专注于股市的投资者，我们认为通过本基金进行定期定投，不失为一种较为省心省力且长期效果不俗的投资方式。而对于那些股市经验丰富的投资者，我们建议在主动配置个股的同时，可根据自己对市场走势的判断，用部分仓位通过指数基金进行快速加减仓的波段操作，这也是目前较多专业机构投资者的惯用方法。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、数量化投资部总监、监察稽核总监及基金会计负责人等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制订的相关制度，负责估值工作决策和执行的机构成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金不符合基金合同约定的收益分配条件，未有收益分配事项。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2012 年上半年, 本基金托管人在对南方沪深 300 指数证券投资基金的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012 年上半年, 南方沪深 300 指数证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方沪深 300 指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内, 南方沪深 300 指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方沪深 300 指数证券投资基金 2012 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查, 以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	118,895,478.37	114,428,994.42
结算备付金		1,724,532.91	272,557.20
存出保证金		589,519.06	391,448.19
交易性金融资产	6.4.3.2	2,333,588,325.29	2,101,182,686.51
其中：股票投资		2,333,588,325.29	2,101,182,686.51
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		14,411,162.33	-
应收利息	6.4.3.5	21,407.13	23,659.03
应收股利		4,662,087.88	-
应收申购款		1,197,992.29	514,377.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		2,475,090,505.26	2,216,813,722.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		7,172,193.15	-
应付赎回款		779,497.33	290,504.31
应付管理人报酬		1,309,593.80	1,216,171.77
应付托管费		302,213.97	280,655.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	1,383,666.84	865,964.59
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	204,080.90	400,082.78
负债合计		11,151,245.99	3,053,378.48
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	2,893,046,976.07	2,740,610,982.25
未分配利润	6.4.3.10	-429,107,716.80	-526,850,638.13
所有者权益合计		2,463,939,259.27	2,213,760,344.12
负债和所有者权益总计		2,475,090,505.26	2,216,813,722.60

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8517 元，基金份额总额 2,893,046,976.07 份。

6.2 利润表

会计主体：南方沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		135,328,134.01	-62,408,051.72
1.利息收入		467,087.29	446,314.19
其中：存款利息收入	6.4.3.11	466,476.11	444,817.74
债券利息收入		611.18	1,496.45
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-114,925,338.91	9,391,191.38
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-143,009,733.48	-13,627,151.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	252,242.42	411,074.85
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	27,832,152.15	22,607,267.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	249,150,143.74	-72,704,626.46
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	636,241.89	459,069.17
减：二、费用		12,397,805.35	12,031,794.44
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	7,906,143.22	7,115,842.95
2. 托管费	6.4.6.2.2	1,824,494.56	1,642,117.53
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	2,462,246.10	3,066,033.22
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.19	204,921.47	207,800.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		122,930,328.66	-74,439,846.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		122,930,328.66	-74,439,846.16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,740,610,982.25	-526,850,638.13	2,213,760,344.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	122,930,328.66	122,930,328.66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	152,435,993.82	-25,187,407.33	127,248,586.49
其中：1.基金申购款	802,060,360.94	-102,900,493.27	699,159,867.67
2.基金赎回款	-649,624,367.12	77,713,085.94	-571,911,281.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,893,046,976.07	-429,107,716.80	2,463,939,259.27
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,708,467,053.03	273,575,609.92	1,982,042,662.95
二、本期经营活动产生	-	-74,439,846.16	-74,439,846.16

的基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	883,090,343.26	65,862,285.76	948,952,629.02
其中：1.基金申购款	1,277,650,519.86	93,816,975.65	1,371,467,495.51
2.基金赎回款	-394,560,176.60	-27,954,689.89	-422,514,866.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-171,295,230.36	-171,295,230.36
五、期末所有者权益（基金净值）	2,591,557,396.29	93,702,819.16	2,685,260,215.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

高良玉

基金管理公司负责人

鲍文革

主管会计工作负责人

鲍文革

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本报告期无会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	118,895,478.37
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	118,895,478.37

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,671,876,919.19	2,333,588,325.29	-338,288,593.90
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,671,876,919.19	2,333,588,325.29	-338,288,593.90

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.3.4 买入返售金融资产

无。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	20,708.64
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	698.49
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	21,407.13

6.4.3.6 其他资产

无。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,383,666.84
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,383,666.84

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,154.76
预提费用	199,926.14
合计	204,080.90

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,740,610,982.25	2,740,610,982.25
本期申购	802,060,360.94	802,060,360.94
本期赎回(以“-”号填列)	-649,624,367.12	-649,624,367.12
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-

本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	2,893,046,976.07	2,893,046,976.07

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	45,959,897.10	-572,810,535.23	-526,850,638.13
本期利润	-126,219,815.08	249,150,143.74	122,930,328.66
本期基金份额交易产生的变动数	-195,535.17	-24,991,872.16	-25,187,407.33
其中：基金申购款	-9,936,817.57	-92,963,675.70	-102,900,493.27
基金赎回款	9,741,282.40	67,971,803.54	77,713,085.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-80,455,453.15	-348,652,263.65	-429,107,716.80

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	452,908.84
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	11,606.09
其他	1,961.18
合计	466,476.11

6.4.3.12 股票投资收益

6.4.3.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	755,175,922.81
减：卖出股票成本总额	898,185,656.29
买卖股票差价收入	-143,009,733.48

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,970,853.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,718,000.00
减：应收利息总额	611.18
债券投资收益	252,242.42

6.4.3.14 衍生工具收益

无

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	27,832,152.15
基金投资产生的股利收益	-
合计	27,832,152.15

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	249,150,143.74
——股票投资	249,150,143.74
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	249,150,143.74

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	280,875.39
转换费收入	355,366.50

合计	636,241.89
----	------------

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	2,462,246.10
银行间市场交易费用	-
合计	2,462,246.10

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	46,246.20
信息披露费	149,179.94
银行费用	495.33
帐户维护费	9,000.00
合计	204,921.47

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构

华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
兴业证券	127,112,778.23	7.78%	52,312,147.40	2.33%
华泰证券	-	-	141,113,940.73	6.29%

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
兴业证券	103,997.27	7.52%	103,997.27	7.52%
华泰证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券	119,947.02	6.37%	119,947.02	6.34%
兴业证券	42,503.91	2.26%	42,503.91	2.25%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,906,143.22	7,115,842.95
其中：支付销售机构的客户维护费	760,516.93	818,433.90

注：支付基金管理人南方基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.65% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.65\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,824,494.56	1,642,117.53

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.6.2.3 销售服务费

无。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	87,879,458.91	87,879,458.91
期间申购/买入总份额	70,521,684.47	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-

期末持有的基金份额	158,401,143.38	87,879,458.91
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	5.48%	3.39%

注：期间申购总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回总份额含转换出份额。

6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年6月30日		2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	118,895,478.37	452,908.84	140,106,516.46	412,038.22

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——非货币市场基金

无。

6.4.8 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000059	辽通化工	2012年6月26日	重大事项公告	7.91	2012年7月3日	8.15	287,041	2,963,985.41	2,270,494.31	-
002500	山西证券	2012年5月15日	重大资产重组	8.19	-	-	238,050	2,045,280.11	1,949,629.50	-

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司总经理负责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进

行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.8 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	118,895,478.37	-	-	-	118,895,478.37
结算备付金	1,724,532.91	-	-	-	1,724,532.91
存出保证金	-	-	-	589,519.06	589,519.06
交易性金融资产	-	-	-	-2,333,588,325.29	2,333,588,325.29
应收证券清算款	-	-	-	14,411,162.33	14,411,162.33
应收利息	-	-	-	21,407.13	21,407.13
应收股利	-	-	-	4,662,087.88	4,662,087.88
应收申购款	915,113.93	-	-	282,878.36	1,197,992.29
资产总计	121,535,125.21	-	-	-2,353,555,380.05	2,475,090,505.26
负债					
应付证券清算款	-	-	-	7,172,193.15	7,172,193.15
应付赎回款	-	-	-	779,497.33	779,497.33
应付管理人报酬	-	-	-	1,309,593.80	1,309,593.80
应付托管费	-	-	-	302,213.97	302,213.97
应付交易费用	-	-	-	1,383,666.84	1,383,666.84
其他负债	-	-	-	204,080.90	204,080.90
负债总计	-	-	-	11,151,245.99	11,151,245.99
利率敏感度缺口	121,535,125.21	-	-	-2,342,404,134.06	2,463,939,259.27
上年度末 2011 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	114,428,994.42	-	-	-	114,428,994.42
结算备付金	272,557.20	-	-	-	272,557.20
存出保证金	-	-	-	391,448.19	391,448.19
交易性金融资产	-	-	-	-2,101,182,686.51	2,101,182,686.51
应收利息	-	-	-	23,659.03	23,659.03

应收申购款	10,668.15	-	-	503,709.10	514,377.25
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	114,712,219.77	-	-	-2,102,101,502.83	2,216,813,722.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	290,504.31	290,504.31
应付管理人报酬	-	-	-	1,216,171.77	1,216,171.77
应付托管费	-	-	-	280,655.03	280,655.03
应付交易费用	-	-	-	865,964.59	865,964.59
其他负债	-	-	-	400,082.78	400,082.78
负债总计	-	-	-	3,053,378.48	3,053,378.48
利率敏感度缺口	114,712,219.77	-	-	-2,099,048,124.35	2,213,760,344.12

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.9.4.2 外汇风险

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中，沪深 300 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,333,588,325.29	94.71	2,101,182,686.51	94.91
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,333,588,325.29	94.71	2,101,182,686.51	94.91

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末（2012 年 6 月 30 日）	上年度末（2011 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	增加约 11,434	增加约 10,333
	沪深 300 指数下降 5%	减少约 11,434	减少约 10,333

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,333,588,325.29	94.28
	其中：股票	2,333,588,325.29	94.28
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	120,620,011.28	4.87
6	其他各项资产	20,882,168.69	0.84
7	合计	2,475,090,505.26	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	14,924,565.61	0.61
B	采掘业	223,599,295.66	9.07
C	制造业	839,659,465.03	34.08
C0	食品、饮料	173,023,607.20	7.02
C1	纺织、服装、皮毛	10,588,295.16	0.43
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	53,822,771.40	2.18
C5	电子	45,966,752.91	1.87
C6	金属、非金属	194,266,114.13	7.88
C7	机械、设备、仪表	256,638,414.48	10.42
C8	医药、生物制品	105,353,509.75	4.28
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	58,135,057.96	2.36
E	建筑业	81,967,743.95	3.33
F	交通运输、仓储业	67,995,176.74	2.76
G	信息技术业	70,559,239.17	2.86
H	批发和零售贸易	79,341,953.30	3.22
I	金融、保险业	731,873,066.37	29.70

J	房地产业	139,146,339.00	5.65
K	社会服务业	18,564,758.65	0.75
L	传播与文化产业	7,821,663.85	0.32
M	综合类	-	-
	合计	2,333,588,325.29	94.71

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	1,586,692	72,575,292.08	2.95
2	600016	民生银行	10,696,513	64,072,112.87	2.60
3	600036	招商银行	5,856,177	63,949,452.84	2.60
4	601328	交通银行	12,117,430	55,013,132.20	2.23
5	600519	贵州茅台	196,699	47,040,565.85	1.91
6	601166	兴业银行	3,575,592	46,411,184.16	1.88
7	600000	浦发银行	5,300,066	43,089,536.58	1.75
8	600030	中信证券	3,261,383	41,191,267.29	1.67
9	000002	万科 A	4,584,173	40,844,981.43	1.66
10	600837	海通证券	3,832,081	36,902,940.03	1.50
11	601088	中国神华	1,561,845	35,110,275.60	1.42
12	601601	中国太保	1,488,551	33,016,061.18	1.34
13	601288	农业银行	11,948,466	30,946,526.94	1.26
14	000858	五粮液	898,760	29,443,377.60	1.19
15	600111	包钢稀土	688,142	27,154,083.32	1.10
16	601939	建设银行	6,390,882	26,841,704.40	1.09
17	601988	中国银行	8,620,476	24,309,742.32	0.99
18	601668	中国建筑	7,103,368	23,725,249.12	0.96
19	600048	保利地产	2,028,159	22,999,323.06	0.93
20	000157	中联重科	2,163,233	21,697,226.99	0.88
21	000651	格力电器	997,110	20,789,743.50	0.84
22	002304	洋河股份	153,422	20,642,930.10	0.84
23	601169	北京银行	2,083,641	20,357,172.57	0.83
24	600031	三一重工	1,438,447	20,023,182.24	0.81
25	601006	大秦铁路	2,816,065	19,796,936.95	0.80
26	000001	深发展 A	1,213,119	18,390,884.04	0.75
27	002024	苏宁电器	1,987,850	16,678,061.50	0.68
28	601818	光大银行	5,744,402	16,314,101.68	0.66

29	600900	长江电力	2,344,081	15,939,750.80	0.65
30	600887	伊利股份	757,033	15,579,739.14	0.63
31	600015	华夏银行	1,621,820	15,358,635.40	0.62
32	601857	中国石油	1,651,979	14,950,409.95	0.61
33	600050	中国联通	4,015,059	14,936,019.48	0.61
34	600104	上汽集团	1,044,263	14,922,518.27	0.61
35	601899	紫金矿业	3,742,035	14,519,095.80	0.59
36	600999	招商证券	1,244,252	14,445,765.72	0.59
37	600585	海螺水泥	947,050	14,035,281.00	0.57
38	000568	泸州老窖	330,081	13,965,727.11	0.57
39	600383	金地集团	2,117,485	13,721,302.80	0.56
40	600256	广汇能源	995,736	13,412,563.92	0.54
41	000063	中兴通讯	931,692	13,006,420.32	0.53
42	601628	中国人寿	710,302	12,998,526.60	0.53
43	600028	中国石化	2,009,140	12,657,582.00	0.51
44	601788	光大证券	952,964	12,550,535.88	0.51
45	000776	广发证券	420,441	12,541,755.03	0.51
46	000983	西山煤电	746,123	11,639,518.80	0.47
47	600518	康美药业	728,819	11,238,388.98	0.46
48	600547	山东黄金	336,977	11,066,324.68	0.45
49	000338	潍柴动力	372,692	11,065,225.48	0.45
50	000069	华侨城 A	1,721,737	10,984,682.06	0.45
51	601989	中国重工	2,083,809	10,814,968.71	0.44
52	600019	宝钢股份	2,487,906	10,747,753.92	0.44
53	000527	美的电器	961,602	10,625,702.10	0.43
54	000792	盐湖股份	301,268	10,173,820.36	0.41
55	600739	辽宁成大	646,278	10,081,936.80	0.41
56	600489	中金黄金	464,638	9,999,009.76	0.41
57	000423	东阿阿胶	247,800	9,914,478.00	0.40
58	600795	国电电力	3,645,184	9,841,996.80	0.40
59	000783	长江证券	1,080,405	9,831,685.50	0.40
60	000538	云南白药	164,307	9,740,118.96	0.40
61	600011	华能国际	1,491,700	9,621,465.00	0.39
62	600362	江西铜业	393,073	9,398,375.43	0.38
63	601699	潞安环能	435,892	9,040,400.08	0.37
64	600690	青岛海尔	762,984	8,942,172.48	0.36
65	000629	攀钢钒钛	1,355,942	8,922,098.36	0.36
66	000895	双汇发展	143,481	8,878,604.28	0.36
67	601600	中国铝业	1,415,300	8,732,401.00	0.35

68	600348	阳泉煤业	569,483	8,713,089.90	0.35
69	600089	特变电工	1,248,106	8,449,677.62	0.34
70	600276	恒瑞医药	292,819	8,406,833.49	0.34
71	000425	徐工机械	585,987	8,403,053.58	0.34
72	601009	南京银行	984,184	8,385,247.68	0.34
73	600406	国电南瑞	447,665	8,366,858.85	0.34
74	000100	TCL 集团	4,014,000	8,148,420.00	0.33
75	000024	招商地产	326,232	8,002,470.96	0.32
76	601669	中国水电	1,818,495	7,946,823.15	0.32
77	601299	中国北车	1,954,863	7,839,000.63	0.32
78	601168	西部矿业	902,742	7,727,471.52	0.31
79	000725	京东方 A	4,038,482	7,713,500.62	0.31
80	600029	南方航空	1,662,714	7,665,111.54	0.31
81	601377	兴业证券	729,217	7,642,194.16	0.31
82	601766	中国南车	1,673,403	7,630,717.68	0.31
83	000402	金融街	1,146,780	7,488,473.40	0.30
84	601111	中国国航	1,183,295	7,277,264.25	0.30
85	600309	烟台万华	512,013	6,835,373.55	0.28
86	601898	中煤能源	866,835	6,709,302.90	0.27
87	000630	铜陵有色	336,650	6,497,345.00	0.26
88	601186	中国铁建	1,457,808	6,487,245.60	0.26
89	600068	葛洲坝	990,898	6,470,563.94	0.26
90	600535	天士力	146,724	6,414,773.28	0.26
91	600100	XD 同方股	752,998	6,340,243.16	0.26
92	600600	青岛啤酒	164,796	6,293,559.24	0.26
93	601390	中国中铁	2,428,325	6,240,795.25	0.25
94	600369	西南证券	549,919	6,219,583.89	0.25
95	600642	申能股份	1,343,630	6,194,134.30	0.25
96	000878	云南铜业	335,356	6,002,872.40	0.24
97	600150	中国船舶	261,071	5,996,800.87	0.24
98	600010	包钢股份	1,216,811	5,938,037.68	0.24
99	000060	中金岭南	683,851	5,894,795.62	0.24
100	000623	吉林敖东	338,821	5,875,156.14	0.24
101	600123	兰花科创	324,572	5,861,770.32	0.24
102	002241	歌尔声学	160,596	5,860,148.04	0.24
103	600009	上海机场	456,250	5,812,625.00	0.24
104	601958	金钼股份	458,350	5,807,294.50	0.24
105	600315	上海家化	148,585	5,796,300.85	0.24
106	601618	中国中冶	2,307,039	5,721,456.72	0.23

107	600549	厦门钨业	129,198	5,673,084.18	0.23
108	601666	平煤股份	559,084	5,657,930.08	0.23
109	600875	东方电气	315,170	5,647,846.40	0.23
110	600583	海油工程	920,914	5,608,366.26	0.23
111	002081	金螳螂	147,254	5,595,652.00	0.23
112	000012	南玻 A	621,635	5,594,715.00	0.23
113	600196	复星医药	541,052	5,578,246.12	0.23
114	000709	河北钢铁	2,011,450	5,491,258.50	0.22
115	002142	宁波银行	546,250	5,451,575.00	0.22
116	000039	中集集团	408,317	5,430,616.10	0.22
117	601117	中国化学	934,450	5,391,776.50	0.22
118	600085	同仁堂	308,347	5,380,655.15	0.22
119	600177	雅戈尔	632,654	5,371,232.46	0.22
120	601991	大唐发电	946,545	5,329,048.35	0.22
121	600188	兖州煤业	280,320	5,320,473.60	0.22
122	002422	科伦药业	113,660	5,303,375.60	0.22
123	601998	中信银行	1,303,381	5,213,524.00	0.21
124	600143	金发科技	873,237	5,213,224.89	0.21
125	600660	福耀玻璃	664,005	5,192,519.10	0.21
126	000009	中国宝安	516,495	5,164,950.00	0.21
127	002415	海康威视	189,446	5,152,931.20	0.21
128	600005	武钢股份	1,911,939	5,143,115.91	0.21
129	000581	威孚高科	187,346	5,133,280.40	0.21
130	000728	国元证券	465,070	5,073,913.70	0.21
131	601919	中国远洋	1,084,750	5,033,240.00	0.20
132	600415	小商品城	644,462	5,026,803.60	0.20
133	000937	冀中能源	328,540	5,016,805.80	0.20
134	600066	宇通客车	223,326	5,015,901.96	0.20
135	600271	航天信息	262,356	4,961,151.96	0.20
136	600881	亚泰集团	897,222	4,934,721.00	0.20
137	002155	辰州矿业	254,060	4,918,601.60	0.20
138	601607	上海医药	455,206	4,857,048.02	0.20
139	600166	福田汽车	665,308	4,756,952.20	0.19
140	600376	首开股份	353,879	4,685,357.96	0.19
141	002202	金风科技	727,443	4,662,909.63	0.19
142	600694	大商股份	139,111	4,653,262.95	0.19
143	600703	三安光电	341,831	4,652,319.91	0.19
144	600809	山西汾酒	123,030	4,637,000.70	0.19
145	601808	中海油服	280,416	4,629,668.16	0.19

146	000528	柳工	372,965	4,628,495.65	0.19
147	600115	东方航空	1,105,550	4,621,199.00	0.19
148	601717	郑煤机	397,664	4,612,902.40	0.19
149	000768	西飞国际	586,640	4,605,124.00	0.19
150	601018	宁波港	1,818,464	4,600,713.92	0.19
151	000562	宏源证券	276,794	4,578,172.76	0.19
152	600153	建发股份	635,851	4,552,693.16	0.18
153	600252	中恒集团	413,620	4,533,275.20	0.18
154	600058	五矿发展	203,009	4,533,190.97	0.18
155	601901	方正证券	866,600	4,402,328.00	0.18
156	600741	华域汽车	489,317	4,389,173.49	0.18
157	600497	驰宏锌锗	310,169	4,364,077.83	0.18
158	000729	燕京啤酒	597,290	4,360,217.00	0.18
159	000933	神火股份	477,326	4,353,213.12	0.18
160	000625	长安汽车	890,490	4,345,591.20	0.18
161	000869	张裕 A	64,455	4,335,243.30	0.18
162	600655	豫园商城	544,506	4,290,707.28	0.17
163	000960	锡业股份	214,681	4,229,215.70	0.17
164	002353	杰瑞股份	86,915	4,215,377.50	0.17
165	600395	盘江股份	156,794	4,214,622.72	0.17
166	000800	一汽轿车	385,395	4,185,389.70	0.17
167	000422	湖北宜化	340,189	4,167,315.25	0.17
168	000758	中色股份	217,842	4,132,462.74	0.17
169	600827	友谊股份	365,300	4,131,543.00	0.17
170	600779	水井坊	168,402	4,087,116.54	0.17
171	000999	华润三九	185,462	4,052,344.70	0.16
172	600832	东方明珠	754,407	4,051,165.59	0.16
173	002106	莱宝高科	199,000	3,993,930.00	0.16
174	601333	广深铁路	1,338,370	3,934,807.80	0.16
175	600649	城投控股	544,099	3,928,394.78	0.16
176	601106	中国一重	1,238,450	3,913,502.00	0.16
177	600259	广晟有色	59,100	3,896,463.00	0.16
178	601118	海南橡胶	558,381	3,836,077.47	0.16
179	000825	太钢不锈	1,079,000	3,808,870.00	0.15
180	600804	鹏博士	633,830	3,764,950.20	0.15
181	000876	新希望	246,875	3,698,187.50	0.15
182	600839	四川长虹	1,748,881	3,690,138.91	0.15
183	002385	大北农	189,850	3,683,090.00	0.15
184	600219	南山铝业	549,596	3,682,293.20	0.15

185	600125	铁龙物流	432,797	3,670,118.56	0.15
186	600208	新湖中宝	882,314	3,643,956.82	0.15
187	002001	新和成	171,868	3,631,570.84	0.15
188	600267	海正药业	206,723	3,613,518.04	0.15
189	600811	东方集团	656,620	3,598,277.60	0.15
190	000401	冀东水泥	255,206	3,588,196.36	0.15
191	600588	用友软件	231,828	3,537,695.28	0.14
192	600320	振华重工	836,391	3,529,570.02	0.14
193	601888	中国国旅	125,050	3,528,911.00	0.14
194	600718	东软集团	406,951	3,503,848.11	0.14
195	600372	中航电子	194,260	3,494,737.40	0.14
196	002038	双鹭药业	108,215	3,484,523.00	0.14
197	601001	大同煤业	317,022	3,471,390.90	0.14
198	000898	鞍钢股份	873,533	3,406,778.70	0.14
199	601633	长城汽车	190,267	3,386,752.60	0.14
200	600893	航空动力	257,967	3,356,150.67	0.14
201	002007	华兰生物	136,437	3,353,621.46	0.14
202	002310	东方园林	57,037	3,348,642.27	0.14
203	002092	中泰化学	437,312	3,345,436.80	0.14
204	600971	恒源煤电	236,760	3,298,066.80	0.13
205	601179	中国西电	825,298	3,284,686.04	0.13
206	601101	昊华能源	189,436	3,243,144.32	0.13
207	600674	川投能源	467,101	3,232,338.92	0.13
208	600216	浙江医药	127,859	3,215,653.85	0.13
209	601918	国投新集	262,900	3,210,009.00	0.13
210	600266	北京城建	210,516	3,197,738.04	0.13
211	600108	亚盛集团	645,357	3,181,610.01	0.13
212	600331	宏达股份	390,928	3,143,061.12	0.13
213	600895	张江高科	366,742	3,142,978.94	0.13
214	000718	苏宁环球	387,014	3,134,813.40	0.13
215	601928	凤凰传媒	361,436	3,108,349.60	0.13
216	600062	华润双鹤	162,460	3,099,736.80	0.13
217	600997	开滦股份	292,307	3,060,454.29	0.12
218	000061	农产品	524,025	3,039,345.00	0.12
219	000778	新兴铸管	453,884	3,036,483.96	0.12
220	000969	安泰科技	245,140	2,998,062.20	0.12
221	600859	王府井	109,530	2,996,740.80	0.12
222	000839	中信国安	445,550	2,994,096.00	0.12
223	600664	哈药股份	454,001	2,991,866.59	0.12

224	600132	重庆啤酒	137,476	2,968,106.84	0.12
225	601933	永辉超市	109,052	2,955,309.20	0.12
226	601992	金隅股份	442,338	2,941,547.70	0.12
227	600352	浙江龙盛	506,119	2,900,061.87	0.12
228	600863	内蒙华电	366,700	2,896,930.00	0.12
229	000046	泛海建设	647,337	2,893,596.39	0.12
230	002146	荣盛发展	264,719	2,885,437.10	0.12
231	601866	中海集运	1,126,852	2,850,935.56	0.12
232	600550	天威保变	325,060	2,837,773.80	0.12
233	600169	太原重工	803,488	2,820,242.88	0.11
234	002069	獐子岛	134,665	2,807,765.25	0.11
235	600498	烽火通信	104,847	2,779,493.97	0.11
236	600118	中国卫星	217,072	2,732,936.48	0.11
237	600221	海南航空	559,882	2,732,224.16	0.11
238	600109	国金证券	189,457	2,726,286.23	0.11
239	000703	恒逸石化	163,831	2,724,509.53	0.11
240	600160	巨化股份	268,440	2,711,244.00	0.11
241	601158	重庆水务	454,639	2,677,823.71	0.11
242	601558	华锐风电	380,806	2,669,450.06	0.11
243	600316	洪都航空	203,717	2,654,432.51	0.11
244	600873	梅花集团	384,754	2,597,089.50	0.11
245	002299	圣农发展	179,372	2,590,131.68	0.11
246	600516	方大炭素	302,875	2,586,552.50	0.10
247	000807	云铝股份	437,370	2,576,109.30	0.10
248	601336	新华保险	75,100	2,571,424.00	0.10
249	600432	吉恩镍业	192,062	2,550,583.36	0.10
250	000680	山推股份	431,440	2,523,924.00	0.10
251	601555	东吴证券	284,015	2,510,692.60	0.10
252	600598	北大荒	336,776	2,508,981.20	0.10
253	600508	上海能源	136,913	2,482,232.69	0.10
254	600812	华北制药	389,640	2,478,110.40	0.10
255	002128	露天煤业	188,520	2,465,841.60	0.10
256	601098	中南传媒	255,150	2,444,337.00	0.10
257	600770	综艺股份	209,196	2,401,570.08	0.10
258	600500	中化国际	353,928	2,392,553.28	0.10
259	600970	中材国际	207,061	2,389,483.94	0.10
260	600170	上海建工	328,600	2,372,492.00	0.10
261	002073	软控股份	281,265	2,357,000.70	0.10
262	600022	山东钢铁	914,400	2,350,008.00	0.10

263	600528	中铁二局	345,493	2,335,532.68	0.09
264	600418	江淮汽车	427,249	2,311,417.09	0.09
265	601566	九牧王	82,200	2,289,270.00	0.09
266	000059	辽通化工	287,041	2,270,494.31	0.09
267	600037	歌华有线	301,325	2,268,977.25	0.09
268	601369	陕鼓动力	232,800	2,155,728.00	0.09
269	000686	东北证券	121,111	2,075,842.54	0.08
270	002344	海宁皮城	79,593	2,075,785.44	0.08
271	000961	中南建设	165,878	2,066,839.88	0.08
272	000780	平庄能源	192,100	2,013,208.00	0.08
273	600595	中孚实业	358,736	2,001,746.88	0.08
274	601099	太平洋	284,730	1,964,637.00	0.08
275	600546	XD 山煤国	93,900	1,964,388.00	0.08
276	002405	四维图新	163,749	1,955,163.06	0.08
277	002500	山西证券	238,050	1,949,629.50	0.08
278	600456	宝钛股份	101,875	1,912,193.75	0.08
279	000559	万向钱潮	377,295	1,897,793.85	0.08
280	002431	棕榈园林	72,710	1,875,190.90	0.08
281	000968	煤气化	121,599	1,854,384.75	0.08
282	002122	天马股份	281,298	1,817,185.08	0.07
283	600096	云天化	131,426	1,742,708.76	0.07
284	600183	生益科技	336,970	1,735,395.50	0.07
285	601718	际华集团	548,000	1,731,680.00	0.07
286	600783	鲁信创投	105,777	1,688,200.92	0.07
287	000021	长城开发	312,335	1,680,362.30	0.07
288	002493	荣盛石化	105,350	1,615,015.50	0.07
289	002399	海普瑞	75,767	1,606,260.40	0.07
290	600151	航天机电	235,739	1,525,231.33	0.06
291	601258	庞大集团	248,247	1,514,306.70	0.06
292	002603	以岭药业	52,305	1,441,002.75	0.06
293	600307	酒钢宏兴	387,472	1,344,527.84	0.05
294	002378	章源钨业	40,600	1,285,396.00	0.05
295	601216	内蒙君正	181,752	1,266,811.44	0.05
296	601233	桐昆股份	136,855	1,196,112.70	0.05
297	601268	二重重装	160,050	981,106.50	0.04
298	002570	贝因美	40,350	813,052.50	0.03
299	002594	比亚迪	37,400	742,764.00	0.03

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601939	建设银行	21,443,664.37	0.97
2	600036	招商银行	18,946,609.25	0.86
3	600016	民生银行	18,311,927.85	0.83
4	601288	农业银行	17,409,129.01	0.79
5	601328	交通银行	17,216,856.30	0.78
6	601318	中国平安	17,142,756.31	0.77
7	601818	光大银行	15,360,476.73	0.69
8	601988	中国银行	13,943,650.45	0.63
9	601166	兴业银行	12,937,518.63	0.58
10	600000	浦发银行	12,822,852.74	0.58
11	600519	贵州茅台	11,322,135.07	0.51
12	601088	中国神华	10,909,677.58	0.49
13	000629	攀钢钒钛	10,547,485.65	0.48
14	600030	中信证券	10,388,554.11	0.47
15	000002	万科 A	10,344,061.62	0.47
16	600011	华能国际	9,702,548.00	0.44
17	600837	海通证券	9,277,035.62	0.42
18	601601	中国太保	8,361,160.13	0.38
19	000858	五粮液	8,057,511.54	0.36
20	601669	中国水电	8,017,865.66	0.36

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601939	建设银行	23,935,780.21	1.08
2	601328	交通银行	23,350,169.72	1.05
3	600036	招商银行	19,973,928.33	0.90
4	600016	民生银行	19,077,664.10	0.86

5	601318	中国平安	18,234,324.94	0.82
6	601166	兴业银行	13,620,453.87	0.62
7	600000	浦发银行	13,390,545.65	0.60
8	600519	贵州茅台	11,774,327.28	0.53
9	601088	中国神华	11,452,995.45	0.52
10	600030	中信证券	10,899,849.00	0.49
11	000002	万科 A	10,725,646.69	0.48
12	600837	海通证券	10,345,170.97	0.47
13	601601	中国太保	8,856,718.34	0.40
14	000858	五粮液	8,418,233.58	0.38
15	601988	中国银行	6,934,080.02	0.31
16	601668	中国建筑	6,436,760.85	0.29
17	600111	包钢稀土	6,111,039.31	0.28
18	601006	大秦铁路	5,934,018.14	0.27
19	601857	中国石油	5,916,887.16	0.27
20	601169	北京银行	5,809,724.42	0.26

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	881,441,151.33
卖出股票收入（成交）总额	755,175,922.81

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	589,519.06
2	应收证券清算款	14,411,162.33
3	应收股利	4,662,087.88
4	应收利息	21,407.13
5	应收申购款	1,197,992.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,882,168.69

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
71,447	40,492.21	1,391,013,483.77	48.08%	1,502,033,492.30	51.92%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	8,186,657.77	0.2830%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 100 万份以上；本只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间 10 万份至 50 万份（含）。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 3 月 25 日）基金份额总额	1,580,754,997.47
本报告期期初基金份额总额	2,740,610,982.25
本报告期基金总申购份额	802,060,360.94
减：本报告期基金总赎回份额	649,624,367.12
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,893,046,976.07

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	2	327,399,926.94	20.04%	279,086.98	20.17%	-
申银万国	2	308,992,798.02	18.92%	261,717.60	18.91%	-
长江证券	1	246,845,918.91	15.11%	209,820.82	15.16%	-
中银证券	1	177,015,797.10	10.84%	151,232.47	10.93%	-
中投证券	1	152,594,545.35	9.34%	129,705.56	9.37%	-
兴业证券	1	127,112,778.23	7.78%	103,997.27	7.52%	-
银河证券	2	112,359,462.76	6.88%	95,974.20	6.94%	-

广发证券	1	66,631,921.89	4.08%	56,430.35	4.08%	-
平安证券	2	42,187,919.60	2.58%	35,434.81	2.56%	-
湘财证券	1	31,507,872.06	1.93%	25,600.21	1.85%	-
国泰君安	1	30,204,196.37	1.85%	25,674.01	1.86%	-
方正证券	1	10,579,324.87	0.65%	8,992.56	0.65%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序。

根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-

长江证券	-	-	-	-	-	-
中银证券	3,970,853.60	100.00%	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于旗下部分基金参加中信银行网上银行和移动银行优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012年6月29日
2	南方基金关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012年6月29日
3	关于注意防范冒用南方基金名义进行的非法证券活动的提示	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012年6月25日
4	南方基金管理有限公司网上直销关于开通电脑 PC 客户端交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012年6月25日
5	南方基金管理有限公司关于旗下部分基金在中天证券推出基金定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012年6月5日
6	南方基金管理有限公司关于恢复直销电话交易服务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012年6月5日
7	南方基金关于旗下部分基金参加华融证券网上交易系统基金定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012年5月31日
8	南方基金关于旗下部分基金参加重庆银行网银申购及网银定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012年5月22日
9	南方基金管理有限公司关于旗下部分基金在渤海证券推出基金定	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012年5月21日

	期定额投资业务的公告		
10	南方基金关于旗下部分基金参加中国农业银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 5 月 2 日
11	南方基金管理有限公司关于旗下部分基金参加邮储银行手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 5 月 2 日
12	南方沪深 300 指数证券投资基金 2012 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 4 月 23 日
13	南方基金关于旗下部分基金参加国泰君安自助式交易系统申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 4 月 9 日
14	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 3 月 31 日
15	南方基金关于开通电子直销汇款交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 3 月 26 日
16	南方基金关于开通光大银行卡网上直销交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 3 月 26 日
17	南方基金关于电子直销开通多交易账户的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 3 月 26 日
18	南方基金关于暂停直销电话交易系统服务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 3 月 23 日
19	南方基金关于暂停网上直销交易系统服务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 3 月 23 日
20	南方基金关于南方 300 基金增加邮储银行为代销机构及开通定投和转换业务并参与网上交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 3 月 16 日
21	南方基金关于开展农行卡网上直销费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 3 月 6 日
22	南方基金关于南方深成基金增加国信证券为代销机构并开通定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 2 月 24 日
23	南方基金关于旗下南方稳健等 21 只开放式证券投资基金增加五矿证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 2 月 20 日
24	南方基金关于南方现金增利基金 B 级增加中国民生银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 2 月 15 日
25	南方基金关于旗下部分基金参加齐鲁证券网上交易系统网上委托申购及定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 2 月 13 日

26	南方基金关于旗下部分基金增加德邦证券为代销机构及开通定投和转换业务并参与网上交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 1 月 9 日
27	南方基金关于旗下部分基金增加华西证券为代销机构并开通定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 1 月 9 日
28	南方基金管理有限公司关于旗下基金在华夏银行开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 1 月 9 日
29	关于注意防范冒用南方基金名义进行的非法证券活动的提示	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 1 月 9 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方沪深 300 指数证券投资基金的文件。
- 2、南方沪深 300 指数证券投资基金基金合同。
- 3、南方沪深 300 指数证券投资基金托管协议。
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

11.2 存放地点

深圳市福田区福华一路 6 号免税商务大厦 31-33 楼

11.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>